

Obligationsanalyse - videregående/påbyggnad

30. september - 1. oktober 2010, København
Adgang til E-learning 16. september

30. September 2010

08.30 **Let morgenmad**

09.00 **Velkomst og præsentation**

09.15 **1. Nøgletal for obligationer**

- Pris og effektiv rente
- Risikonøgletal

11.00 **2. Rentestrukturanalyse**

- Estimation
 - Bootstrapping
 - Matematiske modeller
 - Økonomiske modeller

12.00-13.00 **Lunch**

13.00 **2. Rentestrukturanalyse, fortsat**

- Anvendelse
 - Prissætning og arbitrage
 - Forwardrenter
 - Afkastprognoser
- Delta vector analyse
 - Fortolkning
 - Delta Akvivalente Cash Flows

15.00 **3. Porteføljeoptimering**

- Hvad er porteføljeoptimering?
- Nøgletal for porteføljer
- Efficient rand

16.30 **End of day**

1. oktober 2010

08.30 **Let morgenmad**

09.00 **Resumé**

09.30 **3. Porteføljeoptimering, fortsat**

- Forecasting
- Volatilitet
 - Pris- og rentevolatilitet
 - Beregning
 - Mapping
- Korrelation
- Optimering
- VaR for obligationer
- Stresstesting
- Expected Tracking Error

12.00-13.00 **Lunch**

13.00 **3. Porteføljeoptimering, fortsat**

14.00 **4. Trading strategier/Switch analyse**

- Hvad er et switch?
- Yield pick-up switch
- Duration bets
- Barbell swaps
 - Kurve
 - Arbitrage
 - VaR

16.00 **Afslutning og evaluering**

Pris

Prisen for kurset er DKK 11.500. Prisen inkluderer kursusmateriale og forpløjning, men ikke moms